

Title	確率論へノ積分方程式ノ應用, VI (終り)
Author(s)	吉田, 耕作
Citation	全国紙上数学談話会. 165 p.429-p.441
Issue Date	1939-09-17
oaire:version	VoR
URL	https://doi.org/10.18910/74653
rights	
Note	

Osaka University Knowledge Archive : OUKA

<https://ir.library.osaka-u.ac.jp/>

Osaka University

724. 確率論への積分方程式の應用, VI, (終り)

吉田耕作 (阪大)

最近注目スベキ文献が三ツ出マシタ。

I. J. L. Doob: *Stochastic processes*

with an integral-valued parameter,
Trans. Amer. Math. Soc. 44, 1 (1938) p. 87—
150.

II. W. Doeblin: Sur les propriétés
asymptotiques de mouvements régis par
certains types de chaînes simples, Bult.
math. de la soc. Roumaine des sc. 39, 2
(1937) p. 3—61.

III. M. Fréchet: Recherches théoriques
modernes sur le calcul des probabilités
second livre (1938).

I. homogeneous + stochastic process
ヲ可附番無限次元空間ノ測度ノ見地カラ見直シテ G.D. Birkhoff,
ergodic theorem ヲ武器トシテ取扱ハウト云
フイデアリマス。正攻法 — orthodox デアリ堂々タル
論大デアリマス。併シ其ノ一般論カラ導ク々々ニ、Markov
chain = 関シテ得ラレタ結果ハ、極メテ巧ミナ議論ラシ
テアル II ノオガズット良イ様デアリマス。

III. 「状態ノ数が有限ノ場合ノ Markov chain =
関シテ最新ノ研究迄ヲ、数学ヲ専門トシナイ人ニモワカル様
ニ平易」三百頁ヲ費シテ著イデアリマス。色カナ細イコトヲ
知ルコトが出来テ便利デスガ、百科全書的デ良書デハアリマ
セウガ決シテ名著トハ思ヘマセン。

以下ニハ I, II ヲ参考シテ、前談話ノ定理ニヨリ状態ノ

数が無限の場合、Markov chain フォロワー調査ミマス。
 次ハ Fréchet、寄物ニ於ケル essential 結果ト
 談話 679、定理トノ関係ヲ述べマス。

尚角谷氏ハ Doeblin、論法ヲ一般ニシテ Kryloff ト
 Bogolisuboff、所論 (Ann. of Math. 38, 1
 (1937)) フ「流れ」、ミナラズ Markov process フ
 包含ムニリニヤリ直セルコトヲ見出サレマシタ。線型 opera-
 tor 反復ノ見地カラ取扱ヘル homogeneous sto-
 chastic process、大事ト文献ニ Birkhoff、
 ergodic theorem ニ關スルモノヲ除ケバ大体悉シタ
 條デスカラ談話ハ一先ヅ之ヲ打切りマス。⁽¹⁾

最後ニ談話ニ一オナラヌ御助力ヲ受ケタ角谷等夫氏ニ
 厚ク感謝致シマス。

§11. レッノ收斂定理

(Markov 定理, extension)

定理. $0 \leq x \leq 1, 0 \leq y \leq 1$ ニ於テ可測ト函数
 $p(x, y)$ ガ i) $p(x, y) \geq 0$ 且 $\int_0^1 p(x, y) dy = 1$
 ii) $\bar{E}_i \supset \bar{E}_{i+1}, \lim_{i \rightarrow \infty} \text{mes}(\bar{E}_i) \rightarrow 0$ トル任意ノ可測集
 合ノ系列 $\{\bar{E}_i\}$ ニ對シ、 x ニ關シテ一様 $= \lim_{i \rightarrow \infty} \int_{\bar{E}_i} p(x, y) dy = 0$

(1) A. Khintchine x A. Kolmogoroff, Birkhoff
 ergodic theorem, 研究ハ又機會ニ報告シタ
 思フヲリマス。

ヲ満足スルトスル、然ラバ $(0, 1) =$ 於テ積分可能ナ任意
ノ $f(x) =$ 對シ

$$f_n(y) = \int_0^1 f(x) \frac{p(x, y) + p^{(2)}(x, y) + \dots + p^{(n)}(x, y)}{n} dx \quad (1)$$

ガ $(L, \text{意味テ})$ 強收斂スル。即チ $\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 |f(x) - f_n(x)| dx$
トル如キ積分可能ナ $f^*(x)$ が存在スル。⁽²⁾

注意 1. 簡単ノタメ $= (0, 1)$ ナ考ヘタノデアアレガ、之
ハモット一般ニ出来ルコトハ明カデアアル。

注意 2. Doob (loc. cit.) ハ $\frac{1}{n} \{ p(x, y) + \dots$
 $\dots + p^{(n)}(x, y) \} = p_n(x, y)$ が x ヲ fix シストキ $-y$
ノ函数トシテ弱收斂スルコト、即チ任意ノ可測集合 $E =$ 對シ
テ $\lim_{n \rightarrow \infty} \int_E p_n(x, y) dy$ ノ存在ヲ云ツテヨリマス。上定理
ハズット precise デアリマス。⁽³⁾

(1) $p^{(n)}(x, y) = \int_0^1 p^{(n-1)}(x, z) p(z, y) dz, p^{(1)}(x, y) = p(x, y).$

(2) 條件 ii) ハ 点 x が 点 $y =$ 移ル遷移確率が $x =$ ツイテ “一樣”
ナコトヲ要求シテヨルノデアアル。

(3) Doebelin (loc. cit.) ハ ii) ヨリ エルイ 條件 (§12ヲミ
ラレヨ) ノモト $= \lim_{n \rightarrow \infty} \int_E p_n(x, y) dy$ ノ收斂速度ヲデ
出シテヨリマス。我々ノ 定理 1 ハ 互ニ含ミ合ツテヨリマ
セン。Doebelin ノ論文ヲ又精シク検討スベキ仕事ガ
我々ニ残サレテアル訳デス。

証明: 区間 $(0, 1)$ 上で積分可能な函数全体 L の
 絶対値 $\|f\| = \int_0^1 |f(x)| dx$, 意味は Banach 空間
 L を作る。Fubini の定理より

$$\int \left| \int f(x) p(x, y) dx \right| dy \leq \int |f(x)| \left\{ \int p(x, y) dy \right\} dx \\
 = \int |f(x)| dx = \|f\|$$

を得ルカラ線型函数変換 $T: f(x) \rightarrow g(y) = \int_0^1 f(x) p(x, y) dx$
 の L から L 内へ写シ且 $\|T\| \leq 1$ デアル。実ハ $\|T\|$ 十
 コトハ $f(x) \equiv 1$ トスレバスグワカル。ヨツテ $\|T^n\| \leq 1$
 ($n=1, 2, \dots$)。

Steinhaus の定理⁽¹⁾ により L は weakly com-
 plete ガアルカラ, 単位球 $\|f\| \leq 1$, T = ヨル 像ガ
 weakly compact 十コトヲ云フニハ, $\|f_i\| \leq 1$ 十満
 足スル系列 $\{f_i\}$, T = ヨル 像ガ weakly convergent
 十部分列 $\{f_{i'}\}$ 十含ムコトガ云ヘレバヨイ。 L の con-
 jugate space ハ $M((0, 1))$ (有界な可測函数
 の全体) ガカラ⁽²⁾, 結局 $\int_0^1 \alpha(x) |d(x)| \leq 1$ 十ル如キ全
 十可測函数ニ対シ

$$\int \alpha(y) \left\{ \int f_{i'}(x) p(x, y) dx \right\} dy$$

ガ $i' \rightarrow \infty$ ト共ニ収斂スル。

(1) S. Banach: *Theorie des operations lineaires*.

(2) S. Banach: *loc. cit.* p.

十ル如キ $\{f_{i,j}\}$ が撰ベルトヨイ。所ガ再ハ Fubini, 定
 理ヲ使フト上ノ積分ハ $\int f_{i,j}(x) \left\{ \int \alpha(y) p(x,y) dy \right\} dx$ ト
 書ケルカラ $\int \alpha(y) p(x,y) dy$ ノ全体ガ M ノ絶対値(函
 数ノ絶対値ノ maximum) ノ意味デ separable ナコ
 トガ云ヘレバヨイ。何者, ソノスレバ $\{f_{i,j}(x)\} = \text{diagonal}$
 verfahren ヲマツテ $\{f_{i,j}(x)\}$ ガ得ラレル。惜

$\beta(x) = \int \alpha(y) p(x,y) dy$ ノ形ノ函数全体ノ separability ノ証明。

l. u. b. $|\alpha(y)| \leq 1$ ガカラ, $\alpha(y)$ ハ全テ, $(0,1)$ 内
 ノ有理数ヲ端点トスル区間デ絶対値ノヲ越エナイヤウナ有理
 数値ヲトル階段函数 $\gamma(y) \in L$ ノ絶対値ノ意味デ, 如何程
 デモ近似ノ得ル。 $\gamma(y)$ ノ全体ハ明カニ可附番デアアル。故
 $\alpha(y) = \lim_{n \rightarrow \infty} \gamma_n(y)$ 対シ $\int |\alpha(y) - \gamma_n(y)| dy = 0$ 十ル如キ
 系列 $\{\gamma_n(y)\}$ が存在スル。

惜テ正整数 i 対シ上カラ $\int |\alpha(y) - \gamma_n(y)| dy \leq \frac{1}{2^{2^i}}$

for $n \geq n_i$ 十ル如キ n_i ガ定マラル。 $|\alpha(y) - \gamma_{n_i}(y)| > \frac{1}{2^{2^i}}$

十ル如キ y ノ集合ヲ E_i トスレバ $\text{mes}(E_i) \leq \frac{1}{2^{2^i}}$ 。

今 $n_1 < n_2 < n_3 < \dots$ 十ル如ク n_i ヲ定メタトスレバ,

$\bar{E}_i = \sum_{j=i}^{\infty} E_j =$ 属サナイ y デハ $|\alpha(y) - \gamma_{n_i}(y)| \leq \frac{1}{2^{2^i}}$ 。

且ツ \bar{E}_i ノ点 y デハ $|\alpha(y) - \gamma_{n_i}(y)| \leq |\alpha(y)| + |\gamma_{n_i}(y)|$

≤ 2 。 $\bar{E}_i \supseteq \bar{E}_{i+1} \supseteq \dots$ 且 $\text{mes}(\bar{E}_i) \leq \sum_{j=i}^{\infty} \text{mes}(E_j) \leq \frac{1}{2^{2^{i-1}}} \rightarrow 0$

$i \rightarrow \infty$. 故 = 定理ノ假定 i), ii) = ヲリ

$$\begin{aligned} & \left| \int \alpha(y) p(x, y) dy - \int \beta_{n_i}(y) p(x, y) dy \right| \\ & \leq \int |\alpha(y) - \beta_{n_i}(y)| p(x, y) dy \\ & \leq \int_{\bar{\varepsilon}_i} 2 p(x, y) dy + \frac{1}{2^i} \int_{(0,1) - \bar{\varepsilon}_i} p(x, y) dy \rightarrow 0 \text{ as } i \rightarrow \infty, \end{aligned}$$

斯クシテ $\beta(x)$ 全体ノ中デ, $\beta'(x) = \int \beta(y) p(x, y) dy$,
形ノ可積分個ノ函数カ M ノ意味デ *überall dicht* + コ
トガワカッタ。 ——— 以上 ———

前談話ノ 定理 = ヲレバ $T_\infty \cdot f(x) = \int_0^1 f(x) p_\infty(x, y) dx$
+ ル線型 operator ンハ, T ノ固有値 1 = 属スル固有空間
ヘノ *projection* テアール。ヨツテ次, 如キ確率論的解釈
カ下サレル:

元單位時間ノ後 = x カ y = 移ル遷移確率密度ガ $p^{(n)}(x, y)$ デ表ヘラレル如キ *Markov process*ヲ考ヘル。
 $f(x) \geq 0$, $\int_0^1 f(x) dx = 1$ + ル如キ 密度分布 $f(x)$ ハ,
time = 関スル *Césaro* 平均ノ意味デ, stable + 密
度分布 $f^*(x)$ = 収斂スル。即チ

$$\lim_{n \rightarrow \infty} \int_0^1 f(x) p_n(x, y) dx = \int_0^1 f(x) p_\infty(x, y) dx = f^*(y),$$

$$\int_0^1 f^*(x) p(x, y) dx = f^*(y).$$

$$\text{又明} = \int_0^1 p_\infty(z, x) p(x, y) dx = p_\infty(z, y) \text{ カ成立スルカ}$$

ヲ、 2η fix シタトキ $p_\infty(x, y)$ ハ x ノ 函数トシテ
 $stable$ + 密度分布ヲ 具ヘル。projection ト云フ
 ユトカラ、任意ノ $stable$ + 密度分布 $f(x)$ ハ
 $\int_0^1 f(x) p_\infty(x, y) dx = f(y)$ ヲ満足スル。之レハ任意ノ
 $stable$ + 密度分布 $f(y)$ が special + $p_\infty(x, y)$ ノ
 x = 関スル convex closure トシテ得ラレルコトヲ示
 ス。

§12. Doeblin / 條件ノ 導入

以下 $p(x, y)$ ハ ii) ノ 代リニモツトエルイ次ノ 條件ヲ
 満足スルモノトスル:

Doeblin / 條件 正数 ϵ, η が存在シテ, $\text{mes}(E) \leq \eta$ + ラ $EC = \text{閉シテ}$ 様 =

$$\int_E p(x, y) dy \leq 1 - \epsilon.$$

然ラバ

定理 T ノ 固有値 1 ハ 其ノ multiplicity 有限ナル。

証明: 若シ 然ラズトスレバ, §3 ト 全ク 同様ニシテ⁽¹⁾

$$(*) \begin{cases} \varphi_i(x) \geq 0, \int_0^1 \varphi_i(x) dx = 1, \int_0^1 \varphi_i(x) p(x, y) dx = \varphi_i(y) \\ \text{(fast überall = 等しい)} \\ \varphi_i(x) \varphi_j(x) \equiv 0 \quad (i \neq j) \end{cases}$$

(1) §3 = ハ 誤リガ アッタ。数話 679 = 訂正シテヲキマシタ。

ナル如キ可附番個ノ函数列 $\{p_i(x)\}$ が得ラレル。之カ不合理ナコトヲ云フトヨイ。

$p_i(x) > 0$ ナル x ノ集合ヲ E_i トスルト, $E_i \cap E_j$ ($i \neq j$) ハ 共通点ヲモタヌ。然ル $mes(E_i) \leq \eta$ トスルト,

$$1 = \int_{E_i} p_i(y) dy = \int_{E_i} dy \left\{ \int_{E_i} p_i(x) p(x, y) dx \right\} \text{ カラ}$$

$$\text{Fubiniノ定理} = \text{ヨリ } 1 \leq \int_{E_i} (1-b) p_i(x) dx = 1-b +$$

ル矛盾ヲ得ル。故 $mes(E_i) > \eta$ ナケレバナラヌ。然ラバ $\{p_i(x)\}$ が可附番無限個デハ困ル。ヨツテ実ハ上ノ如キ p ハ p_1, p_2, \dots, p_k ト有限ノ所デ切レル可キデアイル。

系. §3ノトキト同様ニシテ $f(x) = f(y)$, $f(x) \geq 0$ ナル任意ノ $f(x)$ ハ $p_1(x), p_2(x), \dots, p_k(x)$ ノ *non-negative* ナ係数ニヨル一次結合トシテ表ハサレル。之ヲ *fix* スルト $p_\infty(z, x)$ ハ明カニ斯ル $f(x)$ デ

$$\text{カラ } p_\infty(z, x) = \sum_{i=1}^k C_i(z) p_i(x), \quad C_i(z) \geq 0. \quad \text{所ガ}$$

$$\int_0^1 p_\infty(z, x) dx \equiv 1 \text{ デカラ } \sum_{i=1}^k C_i(z) \equiv 1. \quad \text{故ニ §3ト}$$

同ジク次ノ如キ解釈ガ下サレル:

最初 $E_i = \text{アツタ点ハ何時迄ニ}$ 確實 $= E_i$ 内ニ止ル。

$(0, 1)$ 上ノ任意ノ点ハ, *Césaro* 平均ノ意味ニ時間ノ増スト共ニ E_1, E_2, \dots, E_k ノ何レカ 確實 = 入ル。

今一ツ §1, Lemma 2 ト同ジ様ニシテ

定理 M ノ 点 T M ノ 点 $=$ 移ス 線型 operator T :
 $Tf(x) = \int_0^1 p(x, y) f(y) dy = g(x)$ T 考ヘル。然ラバ
 T ノ 絶対値 1 ノ 固有値 λ $\lambda^n = 1$ (n 整数) T 満足
スル。

尚 $p^{(n)}(x, y)$ ノ 収斂ト T ノ 絶対値 1 且ツ $1 =$ 等シ
ク ± 1 固有値ノ 不存在トノ 関係ニ Doedlin ノ 集合論的論
法ヲ 踏襲スレバ出セマスガ、論法ハ 積分方程式ト一寸離レル
ノ 止メテヲキマス。当然積分方程式 流(?)ノ 証明ハデキ
レタス。デキタラ又御報告シマス。

§13. Fréchet ノ 書物カラ

$p_{ij} \geq 0$ 且ツ $\sum_{j=1}^n p_{ij} = 1$ ($i=1, 2, \dots, n$) T 満
足スル 行列 (p_{ij}) , m 乘 $(p_{ij})^m = (p_{ij}^{(m)})$, $m \rightarrow \infty$
 $=$ 於ケル asymptotic + 状態ヲ考ヘマス (§10 参照シ
ラレタシ。) 上記 Fréchet ノ 書物ニハ 次ノ 2 ヲ 分類ガ
與ヘラレタアリマス。

1) $\lim_{m \rightarrow \infty} (p_{ij})^m$ ノ 存在スル 場合。コノ タメノ 必要
条件ハ (p_{ij}) ガ 1 以外ニ 絶対値 1 ノ 固有値ヲ 有セヌコト
デアイル。

2) regular case 上ニ 於テ $\lim_{m \rightarrow \infty} p_{ij}^{(m)}(i, j$
 $= 1, 2, \dots, n)$ ガ イヅレニ 最初ノ sufficient $i =$ in-
dependent + 場合。コノ タメノ 必要條件ハ 1) $=$ 於ケ
ルモノノ 他ニ, 1) ガ (p_{ij}) ノ simple + 固有値ナル

コトヲアナル。

3) *positive regular case.* 上 = 於テ $\lim_{m \rightarrow \infty} p_{ij}^{(m)} = p_j$ が全テ > 0 ナル場合。コノタメノ必要條件ハ 2) = 於ケルモノノ他ニ、 (p_{ij}) ノ固有値 λ = 属スル固有値 λ ぐくともノ成分が全ベテ $\neq 0$ ナルコトデアナル。

4) *the most regular case.* 2) = 於テ $\lim_{m \rightarrow \infty} p_{ij}^{(m)}$ が全ベテ $i = \infty, j = \infty$ independent ナル場合。コノタメノ必要條件ハ 2) = 於ケルモノノ他ニ、

$$\sum_{i=1}^n p_{ik} = 1 \quad (k=1, 2, \dots, n) \text{ ノ成立スルコトデアナル。}$$

以上ノ條件ハ全テ談話 679 ノ 定理 カラタメスク出セマス。念ノタメニ 定理 ヲ今一度述べマス。

complex Banach 空間 L ノ線型 operator T が (i) $\|T^m\| \leq 1$ ($m=1, 2, \dots$), (ii) 整数 k 及ビ *vollstetig* ナ線型 operator V が存在シ $\|T^k - V\| < 1$. 然ラバ *vollstetig* ナ線型 operator T_1, T_2, \dots, T_l 及ビ線型 operator S が

$$\begin{cases} T = \sum_{i=1}^l \lambda_i T_i + S, & T_i^2 = T_i, T_i T_j = 0 \quad (i \neq j), \\ T_i S = S T_i = 0 \\ \|S^m\| \leq \beta / (1 + \varepsilon)^m \quad (\beta, \varepsilon \text{ 正数; } m=1, 2, \dots) \end{cases}$$

ナル如ク存在スル。コノ $\lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_l$ ハ T ノ絶対値 λ ノ固有値。

証明: $T = (p_{ij})$ トヲクト, 任意, $m = \text{對シ}$

$$\sum_{j=1}^n p_{ij}^{(m)} = 1, \quad p_{ij}^{(m)} \geq 0 \quad \text{ハ明カヅカラ } T \text{ ハ條件 (i), (ii)}$$

ヲ満足スル。⁽¹⁾ ヨツテ 定理 ハソノマニ使ヘル。

故ニ 1) ハ明カ。 2) ハ次ノヤウニシテワカル。 $x = (x_1, x_2, \dots, x_n)$ ヲ任意ノ値ニ取ルトスルト假定カラ

$$\lim_{m \rightarrow \infty} \sum_{j=1}^n p_{ij}^{(m)} x_j$$

ハ $i = \text{independent}$. 今ハ勿論 1) ノ Case ヅカラ之ハ, T ノ固有値 $1 = \text{属スル固有空間}$ ガ 1 次元ト云フコトニナル。何者, $\lambda_1 = 1$ トスルト上式ハ値ニ取ルベキト
 $(\lim_{m \rightarrow \infty} T^m) \cdot x = T \cdot x$ トナリ, T ハ 定理 カラ明カニ
 T ノ固有値 $1 = \text{属スル固有空間}$ ノ *projection* ヅカラ。從ツテ 3) ニ亦明カ。

4) ハ次ノコトカラワカル。 $\lim_{m \rightarrow \infty} p_{ij}^{(m)} = \frac{1}{n}$ ハ假定カラ明カ。然ラバ $p_{ik}^{(m+1)} = \sum_{j=1}^n p_{ij}^{(m)} p_{jk} = \text{於テ } m \rightarrow \infty \text{ ナラシメ}$

$$\text{ルト } \frac{1}{n} = \sum_{j=1}^n \frac{1}{n} p_{jk} \quad \text{即チ } \sum_{j=1}^n p_{jk} = 1 \quad \text{ヲ得ル。逆ニ 2) ノ}$$

條件ノ他ニ $\sum_{j=1}^n p_{ji} = 1$ ガ成立シタトスルト *Transposed*

matrix $T' = (p'_{ij})$, $p'_{ij} = p_{ji}$, ガ亦 定理 ノ條件ヲ満足スル。 T ガ 2) ノ條件ヲ満足スルト T' ガ亦 2) ノ條件ヲ

(1) 有限次元ノ行列ハ勿論 *vollstetig*.

満足スルヲ $\lim_{n \rightarrow \infty} p_{ij}^{(n)} \in \lim_{n \rightarrow \infty} p'_{ij}^{(n)}$ 最初, *suffis*

$i = \text{independent}$. 即チ $\lim_{n \rightarrow \infty} p_{ij}^{(n)}$ ハ $i = \infty$ $j = \infty$

independent.

— 以上 —

注意. Fréchet 尚 Césaro 平均 $\lim_{n \rightarrow \infty} \frac{1}{n} \sum_{k=1}^n p_{ij}^{(k)}$

ヲ問題ニシテ *semi-regular*, *semi-positive-regular*,
semi-most-regular 等, *case* ヲ定義シヨレ
 ヲ *case* ノ々々ノ條件ヲ與ヘテヲリマスガ, 之レモ 定理
 ニヨリ上ト同ジヤウニシテ求メラレマス。尚 定理 ニヨレバ
 積分 operator $\int p(x, y) f(x) dy$ ($p(x, y) \geq 0$,
 $\int p(x, y) dy \equiv 1$) ノ *iteration* 1 場合ニモ上ノ如キ
 分類並ビニ條件ノ出セルコトハ明カマス (談話 679 参照).
 同ジ様ニユキマスカラ繰リ返シマセヨ。

原稿ヲ書イテカラ J. Hadamard et M. Fréchet:
Sur les probabilités discontinues des
événements "en chaîne", Zeitsch. für
angew. Math. und Mech. 13 (1933) p. 92-97
 ノ存在ヲ知リマシタ。少シ古イマスガ状態ノ數ノ有限ト場合
 ノ *Markov chain* ニ關スル, 簡ニシテ要ヲ得タニ綜合
 報告マス。